

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Yellow

Fondo Obbligazionario Flessibile

Weekly Report 19 giugno 2020
www.anthilia.it

LIPPER 1

INDICET 5 4 3 2 1 LOWEST

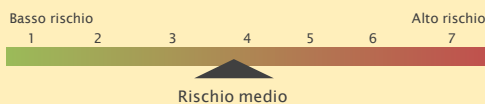


Classe A (Retail)

| | |
|-----------------------|---|
| NAV (Valore quota) | 142,63 |
| Gestore | Markus Ratzinger Anne-Sophie Chouillou |
| AUM comparto (Mln €) | 59,8 |
| Data di lancio | 2 luglio 2012 |
| Valuta di riferimento | Euro € |
| Frequenza del NAV | Giornaliera |
| Tipo di OICR | SICAV UCITS V (armonizzata) |
| Domicilio | Lussemburgo |
| Depositaria | RBC Investor Services |
| Revisore | EY |
| ISIN code | LU1377525735 |
| Bloomberg ticker | PLAYELA LX |
| Management fee (%) | 1,25 |
| Performance fee (%) | 0,70 |
| Investimento minimo | € 250.000 |
| Contatti | info@anthilia.it |
| Sito internet | www.anthilia.it |

Il fondo ha cambiato nome e politica di investimento a partire dal 2 luglio 2012 - in precedenza era Profilo Elite Flessibile

Profilo di rischio



Politica d'Investimento

Comparto flessibile discrezionale, con un obiettivo di volatilità media. Il fondo mira ad incrementare il valore del capitale investito, con un orizzonte temporale di investimento di almeno tre anni. Privilegia gli investimenti in strumenti finanziari di natura obbligazionaria emessi da società del settore finanziario. Tale investimento rappresenta una porzione variabile dell'attivo del Fondo in funzione delle condizioni di mercato e coerentemente con lo stile di gestione flessibile.

Esposizione per emittente

| Emittente | Peso (%) |
|---------------|----------|
| HSBC | 8,23 |
| Mediobanca | 5,69 |
| AXA | 4,91 |
| Unicredit | 4,77 |
| Generali | 4,46 |
| Goldman Sachs | 3,71 |
| Barclays | 3,51 |

Rating del portafoglio

| Rating | Peso (%) |
|--------|----------|
| AAA | 0,00 |
| AA | -10,27 |
| A | 11,11 |
| BBB | 37,30 |
| BB | 28,43 |
| B | 2,43 |
| CCC | 1,66 |
| NR | -12,23 |

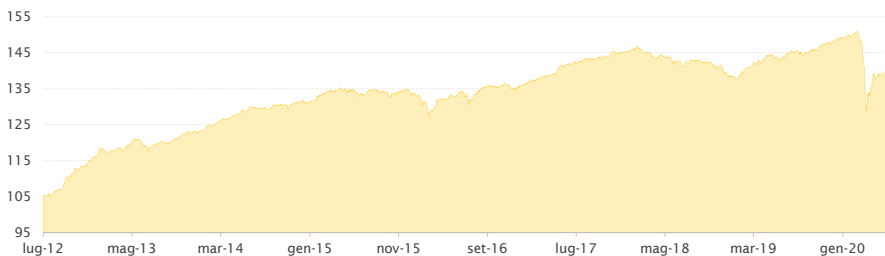
Portafoglio obbligazionario

| | |
|---------------------------|------|
| Duration portafoglio bond | 1,72 |
|---------------------------|------|

Esposizione valutaria

| Valuta | Peso (%) |
|--------|----------|
| EUR | 98,76 |
| USD | 0,43 |
| GBP | 0,72 |
| CHF | 0,10 |

NAV dal lancio



Rendimenti mensili (%)

| | Gen | Feb | Mar | Apr | Mag | Giu | Lug | Ago | Set | Ott | Nov | Dic | Anno |
|------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 2012 | +4,73 | +5,85 | -0,22 | -1,39 | -1,68 | +0,25 | +1,05 | +1,23 | +2,97 | +2,09 | +1,67 | +1,71 | +19,55 |
| 2013 | +0,88 | +0,20 | +0,29 | +1,87 | +0,37 | -1,68 | +0,98 | +0,22 | +0,92 | +1,26 | +0,38 | +0,18 | +5,97 |
| 2014 | +1,15 | +1,30 | +0,35 | +0,95 | +0,84 | +0,54 | +0,03 | +0,49 | -0,17 | +0,37 | +0,52 | -0,02 | +6,54 |
| 2015 | +1,26 | +0,69 | +0,37 | +0,42 | -0,15 | -0,96 | +0,81 | -0,54 | -0,73 | +0,93 | +0,42 | -1,20 | +1,29 |
| 2016 | -1,16 | -1,93 | +2,40 | +0,88 | +0,51 | -1,79 | +2,02 | +1,02 | +0,08 | +0,63 | -1,17 | +0,70 | +2,10 |
| 2017 | +1,08 | +0,54 | +0,41 | +1,34 | +0,90 | +0,42 | +0,51 | +0,04 | +0,41 | +0,79 | +0,17 | +0,20 | +7,03 |
| 2018 | +0,64 | -0,95 | -1,12 | +0,59 | -1,46 | -0,51 | +1,25 | -0,21 | -0,41 | -1,05 | -1,14 | -0,93 | -5,23 |
| 2019 | +1,92 | +1,10 | +0,27 | +1,35 | -0,89 | +1,24 | +0,44 | -0,35 | +0,60 | +0,94 | +0,64 | +0,55 | +8,05 |
| 2020 | +0,33 | -0,36 | -10,67 | +4,54 | +1,30 | +1,32 | | | | | | | -4,19 |

Analisi della performance

Statistiche a 1 anno

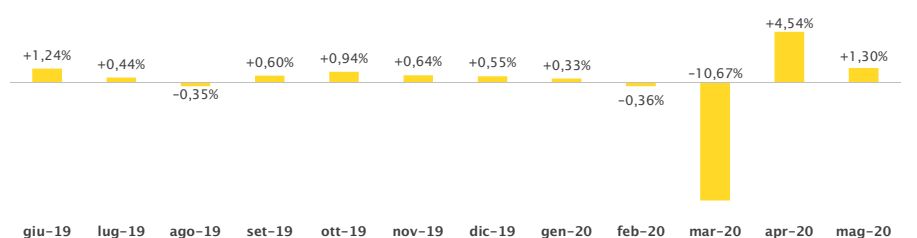
| | |
|---------------------------|--------|
| Rendimento da inizio anno | -4,19% |
| Sharpe ratio | -0,05 |
| Alpha | -0,96% |
| Beta | 0,51 |
| Volatilità annualizzata | 6,38% |

Alpha e Beta sono calcolati in riferimento all'indice Iboxx Euro Financial Subordinated TR

Statistiche dal lancio

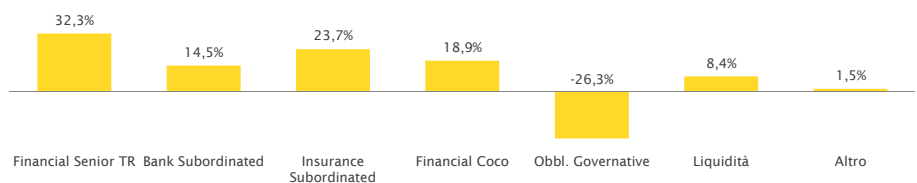
| | |
|--------------------------|---------|
| Rendimento | +36,02% |
| VaR mensile 99% | +5,35% |
| Correlazione col mercato | 0,43 |
| Massimo drawdown | -14,77% |
| Tempo di recupero (mesi) | - |

Rendimenti mensili ultimi 12 mesi

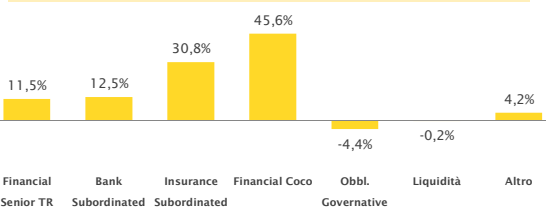


Composizione del portafoglio

Asset allocation



Contribuzione al rischio di portafoglio



Titoli in portafoglio (primi 10)

| Descrizione titolo | (%) |
|---------------------|------|
| HSBC BANK PLC | 7,03 |
| UCGIM 0 05/31/23 | 4,49 |
| BACRED 0 10/30/22 | 3,77 |
| GE 0 02/16/21 | 3,45 |
| AXASA 6.6862 PERP | 2,80 |
| ASSGEN 6.269 PERP | 2,60 |
| FRTR 0 1/4 11/25/20 | 2,52 |
| STANDARD CHART | 2,22 |
| BACRED 3 07/13/24 | 2,18 |
| AXASA 5.453 PERP | 2,14 |

I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. I rendimenti sono al lordo degli oneri fiscali ed al netto degli oneri di gestione. Prima dell'adesione leggere il prospetto informativo disponibile sul sito internet della società di gestione. Si raccomanda la lettura dell'ultimo rendiconto annuale o relazione semestrale disponibile.